

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2024

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

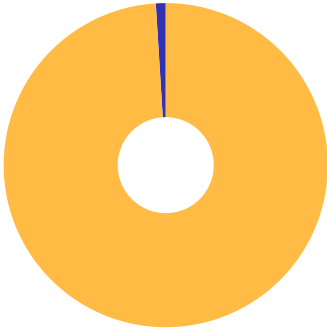
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FI...	D+3	Não há	20.736.400,75	6,25%	697	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	38.676.003,49	11,66%	862	0,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	12.863.678,03	3,88%	638	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF CI...	D+0	Não há	832.621,07	0,25%	1.141	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	29.469.748,15	8,88%	635	0,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	149.098,83	0,04%	140	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 RESP LIMITADA F...	D+0	15/08/2024	10.478.341,10	3,16%	382	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RE...	D+1	Não há	10.371.933,45	3,13%	95	2,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO RESP LIMITADA FIF RE...	D+0	Não há	17.223.499,64	5,19%	149	3,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	10.784.971,26	3,25%	777	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	45.582.806,26	13,74%	820	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	13.488.884,60	4,07%	903	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	42.678.273,99	12,86%	1.155	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+1	Não há	26.443.753,42	7,97%	238	3,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	32.007.221,54	9,65%	1.148	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC...	D+4	Não há	1.844.022,60	0,56%	147	0,27%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA RE...	D+0	Não há	1.531.948,13	0,46%	488	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA F...	D+1	Não há	8.988.806,26	2,71%	113	1,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERE...	D+0	Não há	4.349.614,16	1,31%	1.011	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+3	Não há	572.183,23	0,17%	16.298	0,05%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	258.256,68	0,08%	118	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇ...	D+25	Não há	704.784,72	0,21%	864	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMIT...	D+15	Não há	1.030.964,63	0,31%	200	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS RESP LIMITADA FIF ...	D+23	Não há	686.002,96	0,21%	123	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			331.753.818,95				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			6.354,04	Artigo 6º			
PL Total			331.760.172,99				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Junho / 2024)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	40,00%	132.701.527,58
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	253.336.260,62	76,36%	5,00%	60,00%	90,00%	45.242.176,44
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	75.165.366,11	22,66%	0,00%	25,00%	60,00%	123.886.925,26
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	66.350.763,79
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	16.587.690,95
Total Renda Fixa	100,00%	328.501.626,73	99,02%	5,00%	93,00%	215,00%	

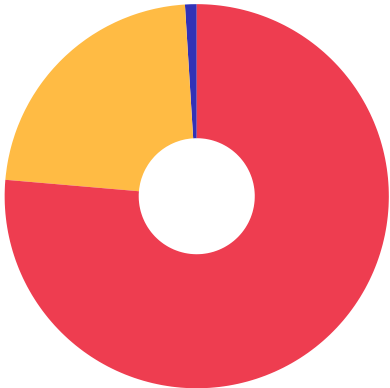


RENDA FIXA 328.501.626,73

RENDA VARIÁVEL 3.252.192,22

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3.252.192,22	0,98%	0,00%	3,00%	30,00%	96.273.953,47
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	33.175.381,90
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	33.175.381,90
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.635.076,38
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.635.076,38
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	3.252.192,22	0,98%	0,00%	5,00%	54,00%	



7º I b 7º III a 8º I

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	33.175.381,90
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	33.175.381,90
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	16.587.690,95

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	215.376.360,23	64,92	5,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	75.165.366,11	22,66	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	3.252.192,22	0,98	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	172.229.049,61	51,91	-
CAIXA DTVM S.A	128.295.108,84	38,67	0,64
BANCO BRADESCO	31.229.660,50	9,41	0,00

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,18%	3,21%	0,95%	3,21%	8,37%	18,43%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	0,20%	2,96%	0,86%	2,96%	8,08%	18,05%	0,98%	1,71%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	0,26%	3,11%	1,05%	3,11%	8,11%	18,30%	0,92%	1,71%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,63%	4,51%	2,00%	4,51%	10,95%	26,28%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREV...	0,61%	4,40%	1,93%	4,40%	10,67%	25,58%	0,24%	0,35%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,61%	4,49%	1,97%	4,49%	10,79%	25,84%	0,25%	0,35%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,39%	3,32%	1,24%	3,32%	8,23%	19,30%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,37%	3,21%	1,18%	3,21%	8,00%	18,98%	0,81%	1,73%
IMA-B (Benchmark)	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF C...	-1,00%	-1,26%	-1,36%	-1,26%	2,73%	16,27%	1,89%	3,88%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	-0,99%	-1,23%	-1,33%	-1,23%	2,76%	16,42%	1,89%	3,87%
BB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,98%	-1,28%	-1,34%	-1,28%	2,67%	16,26%	1,89%	3,89%
IRF-M (Benchmark)	-0,29%	1,51%	-0,17%	1,51%	7,89%	25,94%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	-0,32%	1,37%	-0,24%	1,37%	7,50%	25,11%	1,71%	2,50%
CDI (Benchmark)	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA FIXA

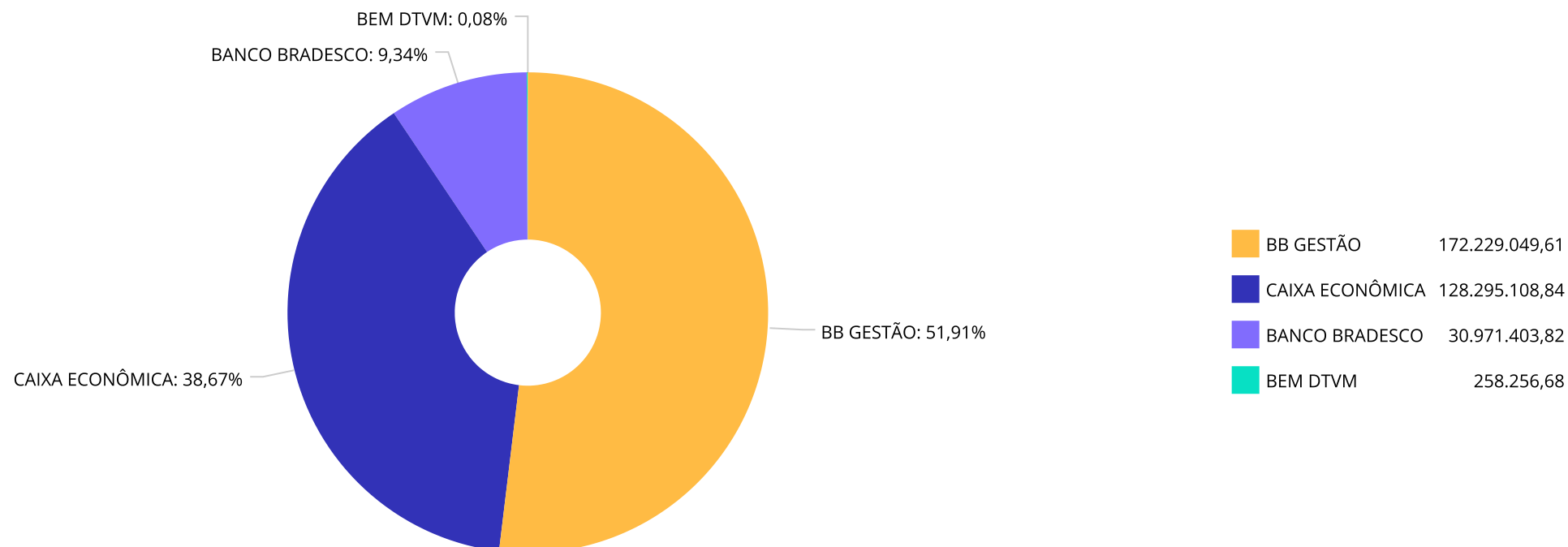
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,36%	2,57%	5,36%	12,19%	27,40%	0,02%	0,09%
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,84%	5,69%	2,69%	5,69%	12,72%	28,36%	0,02%	0,11%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,75%	4,90%	2,38%	4,90%	10,99%	25,26%	0,02%	0,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA ...	0,38%	3,84%	1,40%	3,84%	9,79%	25,12%	0,47%	0,70%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,79%	5,24%	2,53%	5,24%	11,71%	26,83%	0,02%	0,07%

IPCA (Benchmark)	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA LP	0,60%	3,80%	1,59%	3,80%	8,65%	23,59%	0,34%	0,99%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,17%	2,36%	0,55%	2,36%	7,39%	23,06%	0,88%	1,46%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-0,20%	1,81%	0,27%	1,81%	7,18%	22,58%	1,24%	1,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	1,17%	5,78%	2,89%	5,78%	11,46%	-	0,48%	0,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	5,70%	2,85%	5,70%	11,31%	21,59%	0,48%	0,87%

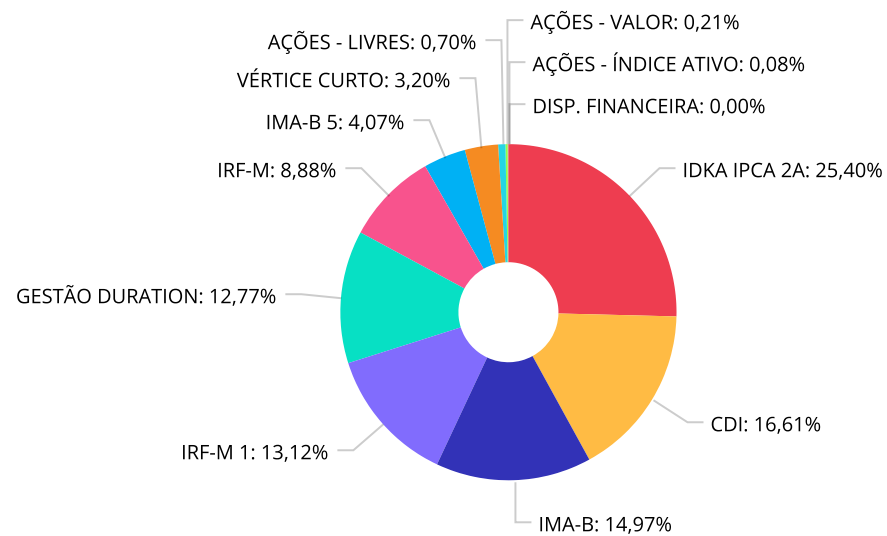
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	1,48%	-7,66%	-3,28%	-7,66%	4,93%	25,74%	-	-
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1,90%	-11,11%	-3,95%	-11,11%	0,53%	13,12%	5,03%	13,53%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-0,11%	-6,86%	-7,64%	-6,86%	4,76%	26,67%	8,59%	15,61%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1,00%	-9,38%	-6,70%	-9,38%	-1,76%	13,42%	6,71%	14,21%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1,37%	-8,82%	-5,44%	-8,82%	2,40%	17,87%	5,99%	14,12%
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-0,13%	-13,33%	-10,63%	-13,33%	-7,64%	10,00%	7,28%	14,88%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Junho / 2024)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2024)

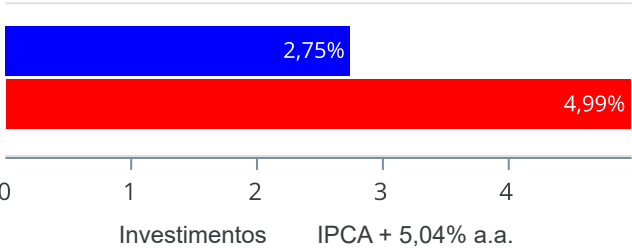


IDKA IPCA 2A	84.258.809,75	CDI	55.112.283,47	IMA-B	49.679.364,90	IRF-M 1	43.510.895,06
GESTÃO DURATION	42.354.200,87	IRF-M	29.469.748,15	IMA-B 5	13.488.884,60	VÉRTICE CURTO	10.627.439,93
AÇÕES - LIVRES	2.307.932,58	AÇÕES - VALOR	686.002,96	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	258.256,68	DISP. FINANCEIRA	6.354,04

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

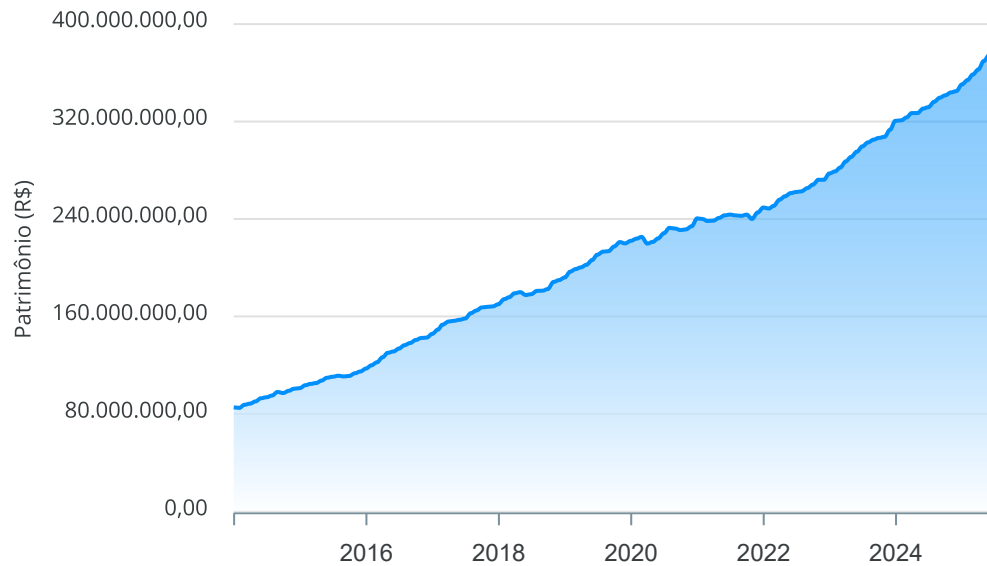
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	320.545.063,17	94.480,82	1.383.400,00	321.023.930,23	1.767.786,24	1.767.786,24	0,55%	0,55%	0,85%	0,85%	64,73%	0,56%
Fevereiro	321.023.930,23	2.335.773,45	1.996.871,57	323.311.170,12	1.948.338,01	3.716.124,25	0,61%	1,16%	1,20%	2,07%	56,18%	0,46%
Março	323.311.170,12	2.935.964,65	1.495.000,00	326.910.726,14	2.158.591,37	5.874.715,62	0,66%	1,83%	0,55%	2,63%	69,72%	0,49%
Abril	326.910.726,14	2.226.398,40	1.545.000,00	326.997.052,11	-595.072,43	5.279.643,19	-0,18%	1,65%	0,81%	3,46%	47,60%	0,90%
Maio	326.997.052,11	2.288.588,47	1.521.000,00	330.658.836,15	2.894.195,57	8.173.838,76	0,88%	2,55%	0,87%	4,37%	58,32%	0,65%
Junho	330.658.836,15	2.754.490,00	2.305.000,00	331.753.818,95	645.492,80	8.819.331,56	0,19%	2,75%	0,60%	4,99%	54,99%	0,90%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



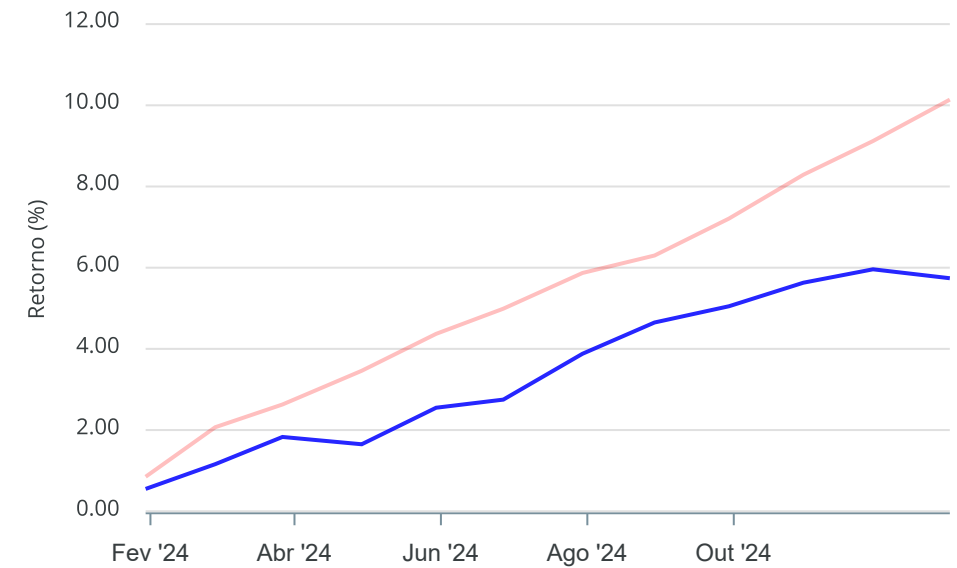
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B
- ☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1
- ☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 RESP LIMITADA FIF...	10.357.433,96	0,00	0,00	10.478.341,10	120.907,14	1,17%	1,17%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	147.395,09	0,00	0,00	149.098,83	1.703,74	1,16%	1,16%	0,48%
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFE...	1.519.264,63	0,00	0,00	1.531.948,13	12.683,50	0,83%	0,83%	0,02%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	31.170.059,85	589.841,89	0,00	32.007.221,54	247.319,80	0,78%	0,79%	0,02%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO RESP LIMITADA FIF REND...	17.094.622,86	0,00	0,00	17.223.499,64	128.876,78	0,75%	0,75%	0,02%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	4.441.323,50	2.164.648,11	2.305.000,00	4.349.614,16	48.642,55	0,74%	0,82%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	42.420.181,57	0,00	0,00	42.678.273,99	258.092,42	0,61%	0,61%	0,25%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF CIC ...	827.610,32	0,00	0,00	832.621,07	5.010,75	0,61%	0,61%	0,24%
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	8.935.291,83	0,00	0,00	8.988.806,26	53.514,43	0,60%	0,60%	0,34%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	20.657.295,36	0,00	0,00	20.736.400,75	79.105,39	0,38%	0,38%	0,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	13.438.843,52	0,00	0,00	13.488.884,60	50.041,08	0,37%	0,37%	0,81%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	38.577.298,14	0,00	0,00	38.676.003,49	98.705,35	0,26%	0,26%	0,92%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	45.494.020,34	0,00	0,00	45.582.806,26	88.785,92	0,20%	0,20%	0,98%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	10.766.619,20	0,00	0,00	10.784.971,26	18.352,06	0,17%	0,17%	0,88%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC R...	1.847.792,85	0,00	0,00	1.844.022,60	-3.770,25	-0,20%	-0,20%	1,24%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	29.563.105,47	0,00	0,00	29.469.748,15	-93.357,32	-0,32%	-0,32%	1,71%
BB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	26.705.709,94	0,00	0,00	26.443.753,42	-261.956,52	-0,98%	-0,98%	1,89%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	12.991.679,36	0,00	0,00	12.863.678,03	-128.001,33	-0,99%	-0,99%	1,89%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP...	10.476.545,35	0,00	0,00	10.371.933,45	-104.611,90	-1,00%	-1,00%	1,89%
Total Renda Fixa	327.432.093,14	2.754.490,00	2.305.000,00	328.501.626,73	620.043,59	0,19%		0,84%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	561.537,48	0,00	0,00	572.183,23	10.645,75	1,90%	1,90%	5,03%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS RESP LIMITADA FIF CI...	676.706,52	0,00	0,00	686.002,96	9.296,44	1,37%	1,37%	5,99%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÃOE...	697.814,49	0,00	0,00	704.784,72	6.970,23	1,00%	1,00%	6,71%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITAD...	1.032.096,19	0,00	0,00	1.030.964,63	-1.131,56	-0,11%	-0,11%	8,59%
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	258.588,33	0,00	0,00	258.256,68	-331,65	-0,13%	-0,13%	7,28%
Total Renda Variável	3.226.743,01	0,00	0,00	3.252.192,22	25.449,21	0,79%		6,90%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	41.855.497,37	0,00	0,00	42.678.273,99	822.776,62	1,97%	1,97%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	29.641.658,31	1.625.835,51	26.000,00	32.007.221,54	765.727,72	2,45%	2,53%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	38.275.836,06	0,00	0,00	38.676.003,49	400.167,43	1,05%	1,05%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO RESP LIMITADA FIF REND...	16.823.547,63	0,00	0,00	17.223.499,64	399.952,01	2,38%	2,38%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	45.195.367,77	0,00	0,00	45.582.806,26	387.438,49	0,86%	0,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 RESP LIMITADA FIF...	10.184.532,06	0,00	0,00	10.478.341,10	293.809,04	2,88%	2,88%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	20.451.061,95	0,00	0,00	20.736.400,75	285.338,80	1,40%	1,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	13.331.543,56	0,00	0,00	13.488.884,60	157.341,04	1,18%	1,18%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	3.907.406,51	5.643.641,36	5.345.000,00	4.349.614,16	143.566,29	1,50%	2,57%
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	8.848.003,35	0,00	0,00	8.988.806,26	140.802,91	1,59%	1,59%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	10.725.865,78	0,00	0,00	10.784.971,26	59.105,48	0,55%	0,55%
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFE...	1.491.872,49	0,00	0,00	1.531.948,13	40.075,64	2,69%	2,69%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF CIC ...	816.892,22	0,00	0,00	832.621,07	15.728,85	1,93%	1,93%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC R...	1.838.986,17	0,00	0,00	1.844.022,60	5.036,43	0,27%	0,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	144.962,32	0,00	0,00	149.098,83	4.136,51	2,85%	2,85%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	29.540.010,05	0,00	0,00	29.469.748,15	-70.261,90	-0,24%	-0,24%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP...	10.514.763,32	0,00	0,00	10.371.933,45	-142.829,87	-1,36%	-1,36%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	13.037.090,43	0,00	0,00	12.863.678,03	-173.412,40	-1,33%	-1,33%
BB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	26.804.079,64	0,00	0,00	26.443.753,42	-360.326,22	-1,34%	-1,34%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
Total Renda Fixa	323.428.976,99	7.269.476,87	5.371.000,00	328.501.626,73	3.174.172,87	0,98%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	595.704,62	0,00	0,00	572.183,23	-23.521,39	-3,95%	-3,95%
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	288.913,41	0,00	0,00	258.256,68	-30.656,73	-10,61%	-10,63%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS RESP LIMITADA FIF CI...	725.473,87	0,00	0,00	686.002,96	-39.470,91	-5,44%	-5,44%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÃOE...	755.371,83	0,00	0,00	704.784,72	-50.587,11	-6,70%	-6,70%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITAD...	1.116.285,42	0,00	0,00	1.030.964,63	-85.320,79	-7,64%	-7,64%
Total Renda Variável	3.481.749,15	0,00	0,00	3.252.192,22	-229.556,93	-6,59%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	40.846.401,02	0,00	0,00	42.678.273,99	1.831.872,97	9,34%	4,48%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	28.078.371,77	2.468.232,59	54.400,00	32.007.221,54	1.515.017,18	10,50%	5,24%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	44.274.346,22	0,00	0,00	45.582.806,26	1.308.460,04	5,29%	2,96%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	37.508.215,66	0,00	0,00	38.676.003,49	1.167.787,83	6,11%	3,11%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO RESP LIMITADA FIF REND...	16.418.337,91	0,00	0,00	17.223.499,64	805.161,73	10,12%	4,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	19.676.969,84	296.871,57	0,00	20.736.400,75	762.559,34	8,12%	3,84%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 RESP LIMITADA FIF...	10.194.418,78	0,00	292.644,46	10.478.341,10	576.566,78	7,39%	5,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	13.069.310,62	0,00	0,00	13.488.884,60	419.573,98	5,92%	3,21%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	29.072.539,64	0,00	0,00	29.469.748,15	397.208,51	1,63%	1,37%
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	8.660.025,36	0,00	0,00	8.988.806,26	328.780,90	7,16%	3,80%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	4.113.358,07	9.870.591,63	9.895.000,00	4.349.614,16	260.664,46	9,88%	5,36%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	10.536.390,35	0,00	0,00	10.784.971,26	248.580,91	6,17%	2,36%
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFE...	1.449.530,95	0,00	0,00	1.531.948,13	82.417,18	10,79%	5,69%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF CIC ...	797.526,74	0,00	0,00	832.621,07	35.094,33	9,16%	4,40%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC R...	1.811.282,17	0,00	0,00	1.844.022,60	32.740,43	3,28%	1,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	145.216,82	0,00	4.227,11	149.098,83	8.109,12	7,24%	5,70%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP...	10.504.601,58	0,00	0,00	10.371.933,45	-132.668,13	-2,18%	-1,26%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	13.023.270,84	0,00	0,00	12.863.678,03	-159.592,81	-2,00%	-1,23%
BB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	26.786.308,26	0,00	0,00	26.443.753,42	-342.554,84	-2,10%	-1,28%
Total Renda Fixa	316.966.422,60	12.635.695,79	10.246.271,57	328.501.626,73	9.145.779,91	2,86%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	297.977,27	0,00	0,00	258.256,68	-39.720,59	-17,68%	-13,33%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS RESP LIMITADA FIF CI...	752.345,11	0,00	0,00	686.002,96	-66.342,15	-13,17%	-8,82%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	643.670,32	0,00	0,00	572.183,23	-71.487,09	-14,26%	-11,11%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÃOE...	777.746,04	0,00	0,00	704.784,72	-72.961,32	-17,12%	-9,38%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITAD...	1.106.901,83	0,00	0,00	1.030.964,63	-75.937,20	-8,24%	-6,86%
Total Renda Variável	3.578.640,57	0,00	0,00	3.252.192,22	-326.448,35	-9,12%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

